

广发高股息优享混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59

8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	61
9 开放式基金份额变动	62
10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
11 备查文件目录	64
11.1 备查文件目录.....	64
11.2 存放地点.....	65
11.3 查阅方式.....	65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发高股息优享混合型证券投资基金	
基金简称	广发高股息优享混合	
基金主代码	008704	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	310,627,716.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
下属分级基金的交易代码	008704	008705
报告期末下属分级基金的份额总额	243,781,025.14 份	66,846,691.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票，在深入研究的基础上，精选高股息主题股票进行投资，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金为一只混合型基金，其股票投资占基金资产的比例不低于 60%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析，合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。在境内股票和香港股票方面，本基金将综合考虑以下因素进行两地股票的配置：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、宏观经济因素（如 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）； 2、估值因素（如市场整体估值水平、上市公司利润增长情况等）； 3、政策因素（如财政政策、货币政策、税收政策等）； 4、流动性因素（如货币政策的宽松情况、证券市场的资金面状况等）。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45%+人民币计价的恒生指数收益率×45%+中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	<p>本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	任航
	联系电话	020-83936666	010-66060069
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105828	95599
传真		020-34281105	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东 路3018号2608室	北京市东城区建国门内大街69 号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道 东1号保利国际广场南塔31-33 楼；广东省珠海市横琴新区环 岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		510308	100031
法定代表人		葛长伟	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人 互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利 国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴 新区环岛东路3018号2603-2622室

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
本期已实现收益	10,534,398.94	2,765,161.39
本期利润	11,224,652.74	3,206,349.05
加权平均基金份额本期利润	0.0458	0.0471
本期加权平均净值利润率	4.66%	4.88%
本期基金份额净值增长率	4.90%	4.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
期末可供分配利润	-3,063,870.15	-2,010,580.39
期末可供分配基金份额利润	-0.0126	-0.0301
期末基金资产净值	240,717,154.99	64,836,110.86
期末基金份额净值	0.9874	0.9699
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
基金份额累计净值增长率	-1.26%	-3.01%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发高股息优享混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.07%	0.82%	-2.10%	0.57%	-1.97%	0.25%
过去三个月	0.48%	0.80%	2.79%	0.81%	-2.31%	-0.01%

过去六个月	4.90%	0.97%	3.18%	0.93%	1.72%	0.04%
过去一年	3.26%	0.79%	-6.75%	0.92%	10.01%	-0.13%
过去三年	-26.86%	1.08%	-28.17%	1.09%	1.31%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-1.26%	1.07%	-21.84%	1.11%	20.58%	-0.04%

广发高股息优享混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.10%	0.82%	-2.10%	0.57%	-2.00%	0.25%
过去三个月	0.37%	0.80%	2.79%	0.81%	-2.42%	-0.01%
过去六个月	4.70%	0.97%	3.18%	0.93%	1.52%	0.04%
过去一年	2.85%	0.79%	-6.75%	0.92%	9.60%	-0.13%
过去三年	-27.74%	1.08%	-28.17%	1.09%	0.43%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-3.01%	1.07%	-21.84%	1.11%	18.83%	-0.04%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发高股息优享混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 1 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日)

广发高股息优享混合 A



广发高股息优享混合 C



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡骏	本基金的基金经理；广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金的基金经理；广发中证科创创业 50 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2023-06-13	-	9 年	胡骏先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司量化投资部研究员、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 8 月 24 日)、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2021 年 12 月 29 日至 2023 年 1 月 10 日)。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 14 次，其中 13 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，市场整体呈现区间震荡的走势，板块轮动速度加快，主要指数表现分化，上证综指下跌 0.25%，深证成指下跌 7.10%，创业板指下跌 10.99%，价值风格明显优于成长风格。上半年 ETF 规模持续增长，尤其是以沪深 300 为代表的大盘指数获得大量资金增持，同时 2 月以来北上资金连续四个月净流入，增持稳健价值板块、更偏好大盘龙头。而在新“国九条”之下，一方面，“壳价值”大幅缩水，“炒差、炒壳”等过度投机炒作行为得到抑制，中小盘公司承压；另一方面，价值红利和成长硬科技并举的“哑铃”策略依旧有效。

本报告期内，本基金维持在红利类资产上的布局，积极关注分红提升幅度较大的公司，同时通过定量指标，筛选前期跌幅较大、资金储备充沛、基本面出现改善的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 4.90%，C 类基金份额净值增长率为 4.70%，同期业绩比较基准收益率为 3.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，政策端利好有望推动资本市场高质量发展。当前权益资产的估值水平处于历史较低水平，下半年随着美联储货币政策的逐步清晰，我国货币政策外部约束将会打开，国内货币宽松政策有望加码，伴随着人工智能的普及，成长板块或将受益。但是海外不确定性依旧存在，地缘政治冲突延续、美国大选将在下半年尘埃落定，防御类资产依旧具备配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—广发基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，广发基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发高股息优享混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
-----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,957,865.27	6,694,826.54
结算备付金		1,000,060.86	784,625.60
存出保证金		49,629.77	45,038.58
交易性金融资产	6.4.7.2	295,561,786.19	286,472,211.05
其中：股票投资		284,867,312.77	270,669,510.91
基金投资		-	-
债券投资		10,694,473.42	15,802,700.14
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		1,453,898.58	2,205,374.42
应收股利		270,708.17	-
应收申购款		16,438.34	21,664.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		308,310,387.18	296,223,740.28
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,598,315.19	2,404,256.82
应付赎回款		63,808.47	268,051.38
应付管理人报酬		305,766.08	299,524.66
应付托管费		50,961.01	49,920.77
应付销售服务费		21,742.49	19,698.13
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.70	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	716,527.39	306,382.71
负债合计		2,757,121.33	3,347,834.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	310,627,716.39	312,143,972.00

未分配利润	6.4.7.9	-5,074,450.54	-19,268,066.19
净资产合计		305,553,265.85	292,875,905.81
负债和净资产总计		308,310,387.18	296,223,740.28

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，广发高股息优享混合 A 基金份额净值人民币 0.9874 元，基金份额总额 243,781,025.14 份；广发高股息优享混合 C 基金份额净值人民币 0.9699 元，基金份额总额 66,846,691.25 份；总份额总额 310,627,716.39 份。

6.2 利润表

会计主体：广发高股息优享混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,787,384.51	-21,792,378.91
1.利息收入		46,608.03	286,190.03
其中：存款利息收入	6.4.7.10	41,645.29	269,671.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,962.74	16,518.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,598,273.44	-21,071,128.74
其中：股票投资收益	6.4.7.11	8,705,661.31	-25,724,184.14
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	118,679.28	-5,243.37
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	6,773,932.85	4,658,298.77
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,131,441.46	-1,013,862.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	11,061.58	6,422.44
减：二、营业总支出		2,356,382.72	3,167,622.72
1. 管理人报酬		1,828,045.03	2,517,065.78
2. 托管费		304,674.17	419,511.00

3. 销售服务费		131,298.27	136,053.75
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		0.11	-
8. 其他费用	6.4.7.21	92,365.14	94,992.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,431,001.79	-24,960,001.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,431,001.79	-24,960,001.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,431,001.79	-24,960,001.63

注：比较数据已根据更新发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行重新列示：即将上年度利润表中的“证券出借利息收入”合并于“其他利息收入”中列示。

6.3 净资产变动表

会计主体：广发高股息优享混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	312,143,972.00	-19,268,066.19	292,875,905.81
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	312,143,972.00	-19,268,066.19	292,875,905.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,516,255.61	14,193,615.65	12,677,360.04
（一）、综合收益总额	-	14,431,001.79	14,431,001.79
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,516,255.61	-237,386.14	-1,753,641.75

其中：1.基金申购款	25,147,153.59	-1,198,239.65	23,948,913.94
2.基金赎回款	-26,663,409.20	960,853.51	-25,702,555.69
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	310,627,716.39	-5,074,450.54	305,553,265.85
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	316,854,553.29	8,642,445.36	325,496,998.65
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	316,854,553.29	8,642,445.36	325,496,998.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,489,277.67	-23,517,055.35	-20,027,777.68
(一)、综合收益总额	-	-24,960,001.63	-24,960,001.63
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	3,489,277.67	1,442,946.28	4,932,223.95
其中：1.基金申购款	35,853,138.52	2,910,468.92	38,763,607.44
2.基金赎回款	-32,363,860.85	-1,467,522.64	-33,831,383.49
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	320,343,830.96	-14,874,609.99	305,469,220.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发高股息优享混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2019]2753 号《关于准予广发高股息优享混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发高股息优享混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2020 年 1 月 2 日向社会公开发发行募集并于 2020 年 1 月 20 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 1 月 16 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 4,773,512,020.10 元，有效认购户数为 54,801 户。其中广发高股息优享混合 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 3,557,500,284.30 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 426,283.93 元；广发高股息优享混合 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 1,215,477,312.44 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 108,139.43 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核

算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	9,957,865.27
等于：本金	9,956,233.47
加：应计利息	1,631.80
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	9,957,865.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	290,014,299.52	-	284,867,312.77	-5,146,986.75	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所 市场	10,516,044.51	163,637.42	10,694,473.42	14,791.49
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	10,516,044.51	163,637.42	10,694,473.42	14,791.49
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	300,530,344.03	163,637.42	295,561,786.19	-5,132,195.26	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	37.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	636,405.08
其中：交易所市场	636,405.08
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,084.60
合计	716,527.39

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发高股息优享混合 A		
项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	249,456,210.24	249,456,210.24
本期申购	5,166,423.92	5,166,423.92
本期赎回（以“-”号填列）	-10,841,609.02	-10,841,609.02
本期末	243,781,025.14	243,781,025.14

金额单位：人民币元

广发高股息优享混合 C		
项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,687,761.76	62,687,761.76
本期申购	19,980,729.67	19,980,729.67
本期赎回（以“-”号填列）	-15,821,800.18	-15,821,800.18
本期末	66,846,691.25	66,846,691.25

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发高股息优享混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,347,138.01	-50,001,237.15	-14,654,099.14
本期期初	35,347,138.01	-50,001,237.15	-14,654,099.14
本期利润	10,534,398.94	690,253.80	11,224,652.74
本期基金份额交易产生的变动数	-737,669.09	1,103,245.34	365,576.25
其中：基金申购款	784,891.40	-775,946.44	8,944.96
基金赎回款	-1,522,560.49	1,879,191.78	356,631.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,143,867.86	-48,207,738.01	-3,063,870.15

单位：人民币元

广发高股息优享混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,956,352.26	-12,570,319.31	-4,613,967.05
本期期初	7,956,352.26	-12,570,319.31	-4,613,967.05
本期利润	2,765,161.39	441,187.66	3,206,349.05
本期基金份额交易产生的变动数	490,632.02	-1,093,594.41	-602,962.39
其中：基金申购款	2,317,130.27	-3,524,314.88	-1,207,184.61
基金赎回款	-1,826,498.25	2,430,720.47	604,222.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,212,145.67	-13,222,726.06	-2,010,580.39

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,854.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,423.96
其他	367.12
合计	41,645.29

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,705,661.31
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,705,661.31

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	871,773,955.31
减：卖出股票成本总额	861,134,215.00
减：交易费用	1,934,079.00
买卖股票差价收入	8,705,661.31

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	128,019.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,339.74
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	118,679.28
----	------------

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,898,134.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,559,203.78
减：应计利息总额	348,256.98
减：交易费用	13.39
买卖债券差价收入	-9,339.74

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,773,932.85
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,773,932.85

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	1,131,441.46
——股票投资	1,093,689.97
——债券投资	37,751.49
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,131,441.46

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	4,347.32
基金转换费收入	6,714.26
合计	11,061.58

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	15,912.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	7,118.14
账户维护费	9,000.00
其他	662.40
合计	92,365.14

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	144,840,772.60	8.30%	619,640,749.20	73.45%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	1,335,721.78	6.45%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期债券回购成

		交总额的 比例		交总额的 比例
广发证券股份有限公司	-	-	15,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券股份有限公司	136,051.31	10.24%	119,871.11	18.84%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券股份有限公司	576,248.51	77.95%	576,248.51	96.20%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务；

4、自 2024 年 7 月 1 日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,828,045.03	2,517,065.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	444,417.61	647,254.02

应支付基金管理人的净管理费	1,383,627.42	1,869,811.76
---------------	--------------	--------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

根据本基金管理人 2023 年 7 月 8 日发布的《关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金的管理费年费率由 1.50% 调整为本费率。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	304,674.17	419,511.00

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

根据本基金管理人 2023 年 7 月 8 日发布的《关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金的托管费年费率由 0.25% 调整为本费率。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	23,738.02	23,738.02
中国农业银行股份有限公司	-	3,349.30	3,349.30
广发证券股份有限公司	-	66,017.15	66,017.15
合计	-	93,104.47	93,104.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	4,002.38	4,002.38
中国农业银行股份有限公司	-	3,672.33	3,672.33
广发证券股份有限公司	-	84,248.41	84,248.41
合计	-	91,923.12	91,923.12

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率

的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发高股息优享混合 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发高股息优享混合 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	9,957,865.27	29,854.21	24,802,692.03	261,899.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月	新股流通受限	126.89	188.01	603.00	42,508.15	113,370.03	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,287.00	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	1,051.00	21,608.56	21,608.56	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	109.00	9,478.64	19,067.37	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481.00	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	150.00	5,972.74	13,686.00	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	686.00	8,149.68	13,020.28	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	189.00	8,495.55	12,460.77	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247.00	4,905.42	10,499.97	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	523.00	8,205.87	9,827.17	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576.00	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219.00	4,255.17	8,098.62	-
30158	中瑞	2024-0	6个月	新股	21.73	25.26	306.00	6,649.	7,729.	-

7	股份	3-27		流通受限				38	56	
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222.00	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	414.00	9,381.24	6,578.46	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	383.00	6,204.60	6,112.68	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	156.00	4,056.00	5,848.44	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184.00	3,199.76	3,790.40	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	128.00	2,988.80	3,216.64	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107.00	2,276.96	3,155.43	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	45.00	3,260.70	3,062.70	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72.00	2,748.96	2,800.80	-

001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	199.00	3,379.02	2,682.52	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173.00	2,045.54	2,638.25	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	104.00	3,018.08	2,637.44	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股等，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效

评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,592,300.27	15,802,700.14
合计	10,592,300.27	15,802,700.14

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	19,332.57	-
AAA 以下	82,840.58	-
未评级	-	-
合计	102,173.15	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运

行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,957,865.27	-	-	-	9,957,865.27
结算备付金	1,000,060.86	-	-	-	1,000,060.86
存出保证金	49,629.77	-	-	-	49,629.77
交易性金融资产	10,694,473.42	-	-	284,867,312.77	295,561,786.1

					9
应收清算款	-	-	-	1,453,898.58	1,453,898.58
应收股利	-	-	-	270,708.17	270,708.17
应收申购款	-	-	-	16,438.34	16,438.34
资产总计	21,702,029.32	-	-	286,608,357.86	308,310,387.18
负债					
应付清算款	-	-	-	1,598,315.19	1,598,315.19
应付赎回款	-	-	-	63,808.47	63,808.47
应付管理人报酬	-	-	-	305,766.08	305,766.08
应付托管费	-	-	-	50,961.01	50,961.01
应付销售服务费	-	-	-	21,742.49	21,742.49
应交税费	-	-	-	0.70	0.70
其他负债	-	-	-	716,527.39	716,527.39
负债总计	-	-	-	2,757,121.33	2,757,121.33
利率敏感度缺口	21,702,029.32	-	-	283,851,236.53	305,553,265.85
上年度末					
2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,694,826.54	-	-	-	6,694,826.54
结算备付金	784,625.60	-	-	-	784,625.60
存出保证金	45,038.58	-	-	-	45,038.58
交易性金融资产	15,802,700.14	-	-	270,669,510.91	286,472,211.05
应收清算款	-	-	-	2,205,374.42	2,205,374.42
应收申购款	-	-	-	21,664.09	21,664.09
资产总计	23,327,190.86	-	-	272,896,549.42	296,223,740.28
负债					
应付清算款	-	-	-	2,404,256.82	2,404,256.82
应付赎回款	-	-	-	268,051.38	268,051.38
应付管理人报酬	-	-	-	299,524.66	299,524.66
应付托管费	-	-	-	49,920.77	49,920.77
应付销售服务费	-	-	-	19,698.13	19,698.13
其他负债	-	-	-	306,382.71	306,382.71

负债总计	-	-	-	3,347,834.47	3,347,834.47
利率敏感度缺口	23,327,190.86	-	-	269,548,714.95	292,875,905.81

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-8,586.03	-1,623.56
市场利率下降 25 个基点	8,599.97	1,623.90	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	19,502,978.59	-	19,502,978.59
应收股利	-	270,708.17	-	270,708.17
资产合计	-	19,773,686.76	-	19,773,686.76
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	19,773,686.76	-	19,773,686.76
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	15,836,035.93	-	15,836,035.93
资产合计	-	15,836,035.93	-	15,836,035.93
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	15,836,035.93	-	15,836,035.93

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	988,684.34	791,801.80
	所有外币相对人民币贬值 5%	-988,684.34	-791,801.80

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	284,867,312.77	93.23	270,669,510.91	92.42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	102,173.15	0.03	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	284,969,485.92	93.26	270,669,510.91	92.42

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上升 5%	5,697,957.79	5,091,804.55
	下降 5%	-5,697,957.79	-5,091,804.55

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	284,602,255.32
第二层次	10,637,911.38
第三层次	321,619.49
合计	295,561,786.19

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	284,867,312.77	92.40
	其中：普通股	284,867,312.77	92.40
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,694,473.42	3.47
	其中：债券	10,694,473.42	3.47
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,957,926.13	3.55
8	其他各项资产	1,790,674.86	0.58
9	合计	308,310,387.18	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 19,502,978.59 元，占基金资产净值比例 6.38%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	389,290.00	0.13
B	采矿业	18,187,246.80	5.95
C	制造业	103,749,639.62	33.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,908,270.00	2.92
E	建筑业	13,102,209.00	4.29
F	批发和零售业	12,376,111.08	4.05
G	交通运输、仓储和邮政业	24,473,054.00	8.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,383,396.80	2.09
J	金融业	57,868,262.60	18.94
K	房地产业	3,462,310.00	1.13
L	租赁和商务服务业	4,228,409.60	1.38
M	科学研究和技术服务业	901,426.00	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	3,693,518.68	1.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,641,190.00	2.50
S	综合	-	-
	合计	265,364,334.18	86.85

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	6,584,628.43	2.15
原材料	-	-
工业	2,699,068.56	0.88
非日常生活消费品	85,098.28	0.03
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	6,411,051.31	2.10
信息技术	100,622.97	0.03
通讯业务	2,305,146.75	0.75
公用事业	1,274,648.87	0.42
房地产	42,713.42	0.01
合计	19,502,978.59	6.38

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601000	唐山港	892,100	4,192,870.00	1.37
2	601988	中国银行	606,800	2,803,416.00	0.92
2	03988	中国银行	301,000	1,057,659.22	0.35
3	601939	建设银行	510,200	3,775,480.00	1.24
4	601390	中国中铁	546,400	3,562,528.00	1.17
5	601658	邮储银行	672,200	3,408,054.00	1.12
6	601398	工商银行	552,000	3,146,400.00	1.03
7	600901	江苏金租	620,000	3,131,000.00	1.02
8	601577	长沙银行	357,000	2,920,260.00	0.96
9	600398	海澜之家	313,100	2,893,044.00	0.95
10	600919	江苏银行	371,600	2,760,988.00	0.90
11	601225	陕西煤业	104,100	2,682,657.00	0.88
12	600028	中国石化	253,500	1,602,120.00	0.52
12	00386	中国石油化工股份	230,000	1,062,176.98	0.35
13	601098	中南传媒	213,600	2,652,912.00	0.87
14	600820	隧道股份	402,100	2,625,713.00	0.86
15	600012	皖通高速	187,800	2,623,566.00	0.86
16	601088	中国神华	35,200	1,561,824.00	0.51
16	01088	中国神华	32,000	1,049,947.07	0.34
17	002327	富安娜	251,500	2,527,575.00	0.83
18	601328	交通银行	183,900	1,373,733.00	0.45
18	03328	交通银行	190,000	1,062,998.40	0.35
19	002966	苏州银行	319,200	2,394,000.00	0.78
20	601963	重庆银行	306,444	2,374,941.00	0.78
21	601169	北京银行	394,900	2,306,216.00	0.75
22	600019	宝钢股份	337,500	2,244,375.00	0.73
23	600985	淮北矿业	133,800	2,239,812.00	0.73
24	601668	中国建筑	382,100	2,028,951.00	0.66
25	601298	青岛港	207,200	1,980,832.00	0.65
26	601006	大秦铁路	272,300	1,949,668.00	0.64
27	603365	水星家纺	124,300	1,945,295.00	0.64
28	600016	民生银行	486,400	1,843,456.00	0.60
29	002948	青岛银行	546,500	1,841,705.00	0.60
30	600475	华光环能	209,400	1,823,874.00	0.60
31	601766	中国中车	232,200	1,743,822.00	0.57

32	601666	平煤股份	152,200	1,704,640.00	0.56
33	00998	中信银行	229,000	1,047,108.64	0.34
33	601998	中信银行	93,900	629,130.00	0.21
34	600350	山东高速	188,900	1,671,765.00	0.55
35	601077	渝农商行	332,700	1,670,154.00	0.55
36	600916	中国黄金	170,000	1,635,400.00	0.54
37	600188	兖矿能源	70,000	1,591,100.00	0.52
37	01171	兖矿能源	1,300	13,241.16	0.00
38	002154	报喜鸟	293,800	1,598,272.00	0.52
39	002839	张家港行	389,300	1,564,986.00	0.51
40	601326	秦港股份	486,800	1,543,156.00	0.51
41	601229	上海银行	212,100	1,539,846.00	0.50
42	00857	中国石油股份	150,000	1,081,525.80	0.35
42	601857	中国石油	42,100	434,472.00	0.14
43	600926	杭州银行	116,100	1,515,105.00	0.50
44	600887	伊利股份	58,200	1,503,888.00	0.49
45	601598	中国外运	262,100	1,475,623.00	0.48
46	601827	三峰环境	172,500	1,464,525.00	0.48
47	601688	华泰证券	117,800	1,459,542.00	0.48
48	002533	金杯电工	145,400	1,446,730.00	0.47
49	600710	苏美达	177,500	1,446,625.00	0.47
50	001872	招商港口	75,000	1,443,750.00	0.47
51	002469	三维化学	252,400	1,438,680.00	0.47
52	601801	皖新传媒	206,000	1,427,580.00	0.47
53	301039	中集车辆	164,300	1,412,980.00	0.46
54	600987	航民股份	200,000	1,412,000.00	0.46
55	000895	双汇发展	58,400	1,388,168.00	0.45
56	601811	新华文轩	98,600	1,381,386.00	0.45
57	000651	格力电器	34,500	1,353,090.00	0.44
58	002674	兴业科技	131,500	1,343,930.00	0.44
59	600737	中粮糖业	139,600	1,338,764.00	0.44
60	601138	工业富联	48,500	1,328,900.00	0.43
61	01898	中煤能源	127,000	1,057,102.48	0.35
61	601898	中煤能源	21,200	264,576.00	0.09
62	601336	新华保险	43,600	1,309,308.00	0.43
63	600694	大商股份	77,660	1,305,464.60	0.43
64	002563	森马服饰	224,500	1,304,345.00	0.43
65	000700	模塑科技	247,900	1,301,475.00	0.43
66	603758	秦安股份	171,200	1,301,120.00	0.43
67	300349	金卡智能	109,000	1,299,280.00	0.43
68	601009	南京银行	123,800	1,286,282.00	0.42
69	600874	创业环保	224,900	1,257,191.00	0.41
70	01339	中国人民保险集团	432,000	1,056,664.40	0.35

70	601319	中国人保	37,700	194,155.00	0.06
71	00883	中国海洋石油	52,000	1,063,089.67	0.35
71	600938	中国海油	5,500	181,500.00	0.06
72	600998	九州通	248,521	1,212,782.48	0.40
73	600729	重庆百货	54,000	1,207,440.00	0.40
74	002034	旺能环境	90,200	1,173,502.00	0.38
75	000404	长虹华意	220,000	1,172,600.00	0.38
76	603551	奥普科技	118,500	1,161,300.00	0.38
77	600377	宁沪高速	90,100	1,135,260.00	0.37
78	300628	亿联网络	30,800	1,132,516.00	0.37
79	00728	中国电信	242,000	1,022,621.43	0.33
79	601728	中国电信	15,600	95,940.00	0.03
80	601601	中国太保	40,000	1,114,400.00	0.36
81	002867	周大生	84,600	1,104,876.00	0.36
82	600018	上港集团	189,000	1,092,420.00	0.36
83	00941	中国移动	15,500	1,089,283.58	0.36
84	600050	中国联通	229,100	1,076,770.00	0.35
85	03668	兖煤澳大利亚	34,400	1,072,179.96	0.35
86	03311	中国建筑国际	110,000	1,070,208.57	0.35
87	603228	景旺电子	33,300	1,058,940.00	0.35
88	002322	理工能科	66,000	1,057,320.00	0.35
89	603878	武进不锈	161,269	1,054,699.26	0.35
90	00392	北京控股	44,000	1,052,137.50	0.34
91	00005	汇丰控股	16,800	1,047,245.54	0.34
92	02328	中国财险	118,000	1,044,653.53	0.34
93	00293	国泰航空	143,000	1,042,800.79	0.34
94	000983	山西焦煤	101,100	1,042,341.00	0.34
95	603323	苏农银行	214,500	1,031,745.00	0.34
96	601318	中国平安	24,700	1,021,592.00	0.33
97	000932	华菱钢铁	223,200	988,776.00	0.32
98	600036	招商银行	28,800	984,672.00	0.32
99	002142	宁波银行	42,900	946,374.00	0.31
100	601512	中新集团	123,600	941,832.00	0.31
101	000090	天健集团	231,700	931,434.00	0.30
102	601838	成都银行	61,100	928,109.00	0.30
103	002807	江阴银行	245,600	925,912.00	0.30
104	600461	洪城环境	78,800	912,504.00	0.30
105	600908	无锡银行	171,300	911,316.00	0.30
106	600548	深高速	85,300	906,739.00	0.30
107	600875	东方电气	49,000	904,050.00	0.30
108	603995	甬金股份	51,400	900,528.00	0.29
109	600098	广州发展	140,600	899,840.00	0.29
110	300758	七彩化学	82,800	890,100.00	0.29
111	601860	紫金银行	338,600	846,500.00	0.28

112	600373	中文传媒	56,800	842,912.00	0.28
113	000415	渤海租赁	325,900	831,045.00	0.27
114	601607	上海医药	42,800	817,908.00	0.27
115	600894	广日股份	70,700	813,050.00	0.27
116	002662	京威股份	266,700	810,768.00	0.27
117	600900	长江电力	27,900	806,868.00	0.26
118	002043	兔宝宝	77,800	806,786.00	0.26
119	603992	松霖科技	43,600	801,804.00	0.26
120	600479	千金药业	77,600	789,192.00	0.26
121	002701	奥瑞金	188,800	785,408.00	0.26
122	300403	汉宇集团	114,647	783,039.01	0.26
123	600755	厦门国贸	109,100	782,247.00	0.26
124	000582	北部湾港	104,500	777,480.00	0.25
125	603299	苏盐井神	81,800	777,100.00	0.25
126	000987	越秀资本	154,900	768,304.00	0.25
127	000786	北新建材	25,100	744,466.00	0.24
128	600790	轻纺城	229,400	738,668.00	0.24
129	605368	蓝天燃气	54,100	737,924.00	0.24
130	002233	塔牌集团	97,900	715,649.00	0.23
131	600713	南京医药	168,600	711,492.00	0.23
132	600104	上汽集团	51,000	706,860.00	0.23
133	002048	宁波华翔	53,900	697,466.00	0.23
134	600480	凌云股份	70,200	690,066.00	0.23
135	600210	紫江企业	129,100	686,812.00	0.22
136	603018	华设集团	75,200	683,568.00	0.22
137	002081	金螳螂	218,600	662,358.00	0.22
138	601163	三角轮胎	43,200	657,504.00	0.22
139	603165	荣晟环保	61,300	651,006.00	0.21
140	002376	新北洋	120,600	650,034.00	0.21
141	000913	钱江摩托	40,900	644,584.00	0.21
142	002061	浙江交科	175,900	642,035.00	0.21
143	605377	华旺科技	48,160	638,120.00	0.21
144	600015	华夏银行	99,600	637,440.00	0.21
145	002478	常宝股份	127,900	636,942.00	0.21
146	002293	罗莱生活	78,700	635,896.00	0.21
147	600390	五矿资本	157,000	635,850.00	0.21
148	300810	中科海讯	41,400	633,834.00	0.21
149	000026	飞亚达	71,700	631,677.00	0.21
150	000030	富奥股份	128,200	629,462.00	0.21
151	300625	三雄极光	59,400	623,106.00	0.20
152	002126	银轮股份	35,600	619,796.00	0.20
153	600733	北汽蓝谷	76,700	619,736.00	0.20
154	002404	嘉欣丝绸	116,900	618,401.00	0.20
155	002959	小熊电器	12,800	615,808.00	0.20

156	600284	浦东建设	115,200	615,168.00	0.20
157	603929	亚翔集成	25,700	614,230.00	0.20
158	002831	裕同科技	23,900	611,601.00	0.20
159	002318	久立特材	26,200	611,246.00	0.20
160	002434	万里扬	124,600	610,540.00	0.20
161	600895	张江高科	32,900	607,992.00	0.20
162	002441	众业达	79,600	603,368.00	0.20
163	603711	香飘飘	43,400	601,090.00	0.20
164	002793	罗欣药业	167,100	598,218.00	0.20
165	603766	隆鑫通用	87,800	595,284.00	0.19
166	300339	润和软件	28,500	589,095.00	0.19
167	000858	五粮液	4,600	588,984.00	0.19
168	002922	伊戈尔	26,900	588,034.00	0.19
169	601369	陕鼓动力	73,300	587,866.00	0.19
170	002027	分众传媒	96,900	587,214.00	0.19
171	000422	湖北宜化	48,800	581,696.00	0.19
172	688036	传音控股	7,560	578,642.40	0.19
173	600642	申能股份	64,100	566,003.00	0.19
174	600026	中远海能	29,000	452,690.00	0.15
174	01138	中远海能	12,000	111,054.90	0.04
175	600325	华发股份	86,200	560,300.00	0.18
176	002128	电投能源	25,000	527,500.00	0.17
177	300401	花园生物	36,400	521,976.00	0.17
178	600741	华域汽车	31,500	515,970.00	0.17
179	002993	奥海科技	13,700	509,640.00	0.17
180	600971	恒源煤电	42,120	502,912.80	0.16
181	600177	雅戈尔	70,300	500,536.00	0.16
182	600150	中国船舶	12,200	496,662.00	0.16
183	002206	海利得	129,800	495,836.00	0.16
184	600282	南钢股份	99,400	495,012.00	0.16
185	000828	东莞控股	54,600	491,946.00	0.16
186	002155	湖南黄金	27,100	490,510.00	0.16
187	600039	四川路桥	62,100	489,969.00	0.16
188	000429	粤高速 A	46,800	487,188.00	0.16
189	600845	宝信软件	15,140	483,420.20	0.16
190	603833	欧派家居	9,000	482,040.00	0.16
191	002371	北方华创	1,500	479,835.00	0.16
192	601019	山东出版	40,300	476,346.00	0.16
193	603886	元祖股份	30,900	465,354.00	0.15
194	601021	春秋航空	8,200	461,906.00	0.15
195	002463	沪电股份	12,600	459,900.00	0.15
196	601872	招商轮船	54,300	458,835.00	0.15
197	600577	精达股份	115,400	458,138.00	0.15
198	600153	建发股份	50,400	450,072.00	0.15

199	603885	吉祥航空	40,800	448,392.00	0.15
200	002130	沃尔核材	31,600	446,192.00	0.15
201	600765	中航重机	21,800	444,720.00	0.15
202	600176	中国巨石	39,900	440,895.00	0.14
203	600742	一汽富维	58,900	438,805.00	0.14
204	601952	苏垦农发	48,100	433,862.00	0.14
205	300627	华测导航	14,500	432,825.00	0.14
206	002001	新和成	22,500	432,000.00	0.14
207	600801	华新水泥	31,300	430,375.00	0.14
208	002557	洽洽食品	15,200	428,488.00	0.14
209	001207	联科科技	29,500	428,340.00	0.14
210	600057	厦门象屿	62,000	421,600.00	0.14
211	688099	晶晨股份	7,103	421,349.96	0.14
212	600546	山煤国际	28,600	418,132.00	0.14
213	603408	建霖家居	31,400	414,166.00	0.14
214	600968	海油发展	100,300	413,236.00	0.14
215	002020	京新药业	39,300	411,471.00	0.13
216	002003	伟星股份	32,400	406,620.00	0.13
217	600690	海尔智家	14,300	405,834.00	0.13
218	000883	湖北能源	67,400	405,074.00	0.13
219	688510	航亚科技	21,581	397,306.21	0.13
220	603889	新澳股份	50,800	393,192.00	0.13
221	601636	旗滨集团	60,400	389,580.00	0.13
222	002053	云南能投	31,800	384,462.00	0.13
223	688093	世华科技	21,000	381,570.00	0.12
224	605166	聚合顺	36,000	377,640.00	0.12
225	603071	物产环能	29,800	373,394.00	0.12
226	600970	中材国际	30,700	370,242.00	0.12
227	603195	公牛集团	4,785	369,019.20	0.12
228	002416	爱施德	41,500	367,275.00	0.12
229	002110	三钢闽光	124,400	366,980.00	0.12
230	300547	川环科技	22,100	361,335.00	0.12
231	600309	万华化学	4,400	355,784.00	0.12
232	002906	华阳集团	13,100	350,556.00	0.11
233	603025	大豪科技	25,100	346,882.00	0.11
234	000423	东阿阿胶	5,500	344,300.00	0.11
235	605099	共创草坪	18,200	344,162.00	0.11
236	600023	浙能电力	48,400	344,124.00	0.11
237	001914	招商积余	34,300	343,686.00	0.11
238	300260	新莱应材	16,300	341,322.00	0.11
239	600007	中国国贸	15,500	340,380.00	0.11
240	000887	中鼎股份	27,700	339,048.00	0.11
241	000975	山金国际	20,800	338,832.00	0.11
242	300910	瑞丰新材	7,700	336,644.00	0.11

243	002244	滨江集团	46,200	335,412.00	0.11
244	600395	盘江股份	55,500	333,555.00	0.11
245	605018	长华集团	36,100	327,066.00	0.11
246	002282	博深股份	51,100	326,529.00	0.11
247	603239	浙江仙通	23,600	323,556.00	0.11
248	600011	华能国际	27,600	265,512.00	0.09
248	00902	华能国际电力股份	10,000	52,844.17	0.02
249	601166	兴业银行	17,700	311,874.00	0.10
250	300217	东方电热	81,000	305,370.00	0.10
251	601111	中国国航	41,200	304,056.00	0.10
252	002847	盐津铺子	7,060	301,956.20	0.10
253	600160	巨化股份	12,400	299,212.00	0.10
254	603848	好太太	23,700	298,383.00	0.10
255	000830	鲁西化工	25,600	296,704.00	0.10
256	605183	确成股份	19,100	295,286.00	0.10
257	600248	陕建股份	81,000	294,030.00	0.10
258	600348	华阳股份	29,500	293,820.00	0.10
259	601818	光大银行	92,000	291,640.00	0.10
260	300453	三鑫医疗	45,600	291,384.00	0.10
261	600704	物产中大	65,700	285,138.00	0.09
262	603722	阿科力	6,300	285,075.00	0.09
263	600989	宝丰能源	16,400	284,212.00	0.09
264	002367	康力电梯	48,600	280,422.00	0.09
265	300396	迪瑞医疗	13,700	278,247.00	0.09
266	301345	涛涛车业	5,000	275,500.00	0.09
267	300418	昆仑万维	8,500	274,040.00	0.09
268	601928	凤凰传媒	24,500	268,520.00	0.09
269	002088	鲁阳节能	22,200	268,398.00	0.09
270	300832	新产业	3,900	263,016.00	0.09
271	600782	新钢股份	78,500	260,620.00	0.09
272	300002	神州泰岳	32,000	259,840.00	0.09
273	300251	光线传媒	30,200	253,982.00	0.08
274	600123	兰花科创	27,900	249,705.00	0.08
275	600567	山鹰国际	159,300	238,950.00	0.08
276	601916	浙商银行	85,400	235,704.00	0.08
277	688169	石头科技	600	235,560.00	0.08
278	002345	潮宏基	49,700	234,584.00	0.08
279	603599	广信股份	19,300	234,109.00	0.08
280	603558	健盛集团	23,400	232,830.00	0.08
281	600795	国电电力	38,800	232,412.00	0.08
282	002895	川恒股份	12,500	228,875.00	0.07
283	601665	齐鲁银行	46,500	228,315.00	0.07
284	601018	宁波港	67,000	227,800.00	0.07

285	002832	比音勒芬	9,400	227,198.00	0.07
286	002443	金洲管道	41,700	222,678.00	0.07
287	600295	鄂尔多斯	22,100	219,232.00	0.07
288	300979	华利集团	3,600	219,060.00	0.07
289	600925	苏能股份	43,300	218,665.00	0.07
290	600905	三峡能源	49,200	214,512.00	0.07
291	000725	京东方 A	52,300	213,907.00	0.07
292	002381	双箭股份	31,700	212,707.00	0.07
293	603999	读者传媒	44,700	211,431.00	0.07
294	600157	永泰能源	178,000	210,040.00	0.07
295	002493	荣盛石化	21,700	209,622.00	0.07
296	600223	福瑞达	29,600	209,272.00	0.07
297	000301	东方盛虹	26,200	208,814.00	0.07
298	600397	安源煤业	115,800	208,440.00	0.07
299	002666	德联集团	57,300	207,426.00	0.07
300	002472	双环传动	9,400	206,988.00	0.07
301	600662	外服控股	51,400	206,114.00	0.07
302	601238	广汽集团	26,000	201,240.00	0.07
303	000157	中联重科	25,800	198,144.00	0.06
304	600048	保利发展	21,900	191,844.00	0.06
305	688617	惠泰医疗	400	182,440.00	0.06
306	601808	中海油服	10,600	182,320.00	0.06
307	002475	立讯精密	4,600	180,826.00	0.06
308	603619	中曼石油	7,700	180,334.00	0.06
309	000544	中原环保	22,900	180,223.00	0.06
310	002851	麦格米特	6,900	178,296.00	0.06
311	600674	川投能源	9,400	176,250.00	0.06
312	000552	甘肃能化	49,800	172,806.00	0.06
313	601699	潞安环能	9,400	170,422.00	0.06
314	601216	君正集团	45,900	169,371.00	0.06
315	603477	巨星农牧	5,900	169,330.00	0.06
316	600808	马钢股份	83,500	168,670.00	0.06
317	603179	新泉股份	4,200	164,808.00	0.05
318	300498	温氏股份	8,200	162,524.00	0.05
319	603587	地素时尚	13,200	162,096.00	0.05
320	02057	中通快递-W	1,050	157,355.16	0.05
321	601816	京沪高铁	28,800	154,656.00	0.05
322	601800	中国交建	17,100	152,874.00	0.05
323	301149	隆华新材	16,400	151,536.00	0.05
324	300406	九强生物	9,800	150,724.00	0.05
325	000100	TCL 科技	34,600	149,472.00	0.05
326	688012	中微公司	1,045	147,616.70	0.05
327	002432	九安医疗	3,600	145,944.00	0.05
328	003816	中国广核	31,300	144,919.00	0.05

329	600000	浦发银行	17,600	144,848.00	0.05
330	002541	鸿路钢构	8,500	144,245.00	0.05
331	603986	兆易创新	1,500	143,430.00	0.05
332	000338	潍柴动力	8,800	142,912.00	0.05
333	002402	和而泰	13,200	141,372.00	0.05
334	605333	沪光股份	4,900	136,465.00	0.04
335	600418	江淮汽车	8,600	136,224.00	0.04
336	603997	继峰股份	13,300	136,059.00	0.04
337	601686	友发集团	26,900	135,307.00	0.04
338	300415	伊之密	6,500	135,070.00	0.04
339	601799	星宇股份	1,200	134,448.00	0.04
340	600655	豫园股份	25,900	133,385.00	0.04
341	000425	徐工机械	18,500	132,275.00	0.04
342	600933	爱柯迪	8,900	131,631.00	0.04
343	600323	瀚蓝环境	6,200	129,580.00	0.04
344	00257	光大环境	36,000	128,797.40	0.04
345	002624	完美世界	16,600	126,160.00	0.04
346	002840	华统股份	7,600	126,084.00	0.04
347	301589	诺瓦星云	666	125,623.53	0.04
348	601128	常熟银行	16,580	125,510.60	0.04
349	600997	开滦股份	18,200	124,852.00	0.04
350	600522	中天科技	7,800	123,630.00	0.04
351	688331	荣昌生物	2,718	117,417.60	0.04
352	601717	郑煤机	7,900	116,920.00	0.04
353	000937	冀中能源	17,300	115,910.00	0.04
354	301498	乖宝宠物	2,147	115,508.60	0.04
355	002273	水晶光电	6,000	101,880.00	0.03
356	601198	东兴证券	12,700	101,092.00	0.03
357	01347	华虹半导体	5,000	100,622.97	0.03
358	601528	瑞丰银行	20,900	98,648.00	0.03
359	002415	海康威视	3,100	95,821.00	0.03
360	000039	中集集团	10,300	95,378.00	0.03
361	000650	仁和药业	16,000	94,400.00	0.03
362	688266	泽璟制药-U	1,735	94,071.70	0.03
363	00371	北控水务集团	42,000	91,998.14	0.03
364	002332	仙琚制药	8,000	91,280.00	0.03
365	00152	深圳国际	16,000	90,975.94	0.03
366	603103	横店影视	6,500	89,960.00	0.03
367	002429	兆驰股份	18,700	89,947.00	0.03
368	002697	红旗连锁	19,200	88,896.00	0.03
369	600489	中金黄金	6,000	88,800.00	0.03
370	000951	中国重汽	6,200	88,784.00	0.03
371	002283	天润工业	20,600	88,374.00	0.03
372	688037	芯源微	985	87,665.00	0.03

373	300347	泰格医药	1,800	87,480.00	0.03
374	603057	紫燕食品	5,700	87,324.00	0.03
375	301096	百诚医药	1,500	87,120.00	0.03
376	601619	嘉泽新能	28,600	86,658.00	0.03
377	000931	中关村	24,500	86,485.00	0.03
378	600064	南京高科	14,200	86,194.00	0.03
379	600066	宇通客车	3,300	85,140.00	0.03
380	600826	兰生股份	15,820	85,111.60	0.03
381	00780	同程旅行	6,000	85,098.28	0.03
382	603568	伟明环保	4,000	82,320.00	0.03
383	600648	外高桥	9,200	81,512.00	0.03
384	688488	艾迪药业	7,767	79,378.74	0.03
385	000001	平安银行	7,600	77,140.00	0.03
386	000538	云南白药	1,500	76,725.00	0.03
387	600332	白云山	2,600	76,258.00	0.02
388	000598	兴蓉环境	10,100	75,952.00	0.02
389	301035	润丰股份	1,700	75,718.00	0.02
390	000063	中兴通讯	2,700	75,519.00	0.02
391	000906	浙商中拓	11,200	75,488.00	0.02
392	601139	深圳燃气	11,300	75,484.00	0.02
393	00956	新天绿色能源	23,000	74,310.41	0.02
394	002078	太阳纸业	5,300	73,935.00	0.02
395	603128	华贸物流	12,800	73,856.00	0.02
396	002158	汉钟精机	4,400	73,568.00	0.02
397	002545	东方铁塔	10,800	73,548.00	0.02
398	06060	众安在线	5,800	71,886.33	0.02
399	000567	海德股份	12,800	71,808.00	0.02
400	688819	天能股份	3,000	71,580.00	0.02
401	600909	华安证券	16,900	71,149.00	0.02
402	688326	经纬恒润-W	1,218	69,827.94	0.02
403	002600	领益智造	9,800	69,776.00	0.02
404	301109	军信股份	4,500	67,275.00	0.02
405	000597	东北制药	17,000	65,790.00	0.02
406	01071	华电国际电力股份	10,000	43,169.76	0.01
406	600027	华电国际	2,800	19,432.00	0.01
407	688009	中国通号	10,400	62,400.00	0.02
408	600883	博闻科技	10,100	62,115.00	0.02
409	01896	猫眼娱乐	8,400	61,715.42	0.02
410	600031	三一重工	3,700	61,050.00	0.02
411	601886	江河集团	12,500	61,000.00	0.02
412	600778	友好集团	15,600	60,684.00	0.02
413	600761	安徽合力	2,800	60,592.00	0.02
414	688550	瑞联新材	2,600	60,294.00	0.02

415	300126	锐奇股份	13,300	60,249.00	0.02
416	300509	新美星	12,800	59,904.00	0.02
417	600235	民丰特纸	13,000	59,800.00	0.02
418	603022	新通联	8,200	59,696.00	0.02
419	002066	瑞泰科技	7,500	59,625.00	0.02
420	300838	浙江力诺	5,800	59,624.00	0.02
421	688656	浩欧博	2,600	59,618.00	0.02
422	300640	德艺文创	15,100	59,494.00	0.02
423	603159	上海亚虹	5,700	59,337.00	0.02
424	01052	越秀交通基建	16,000	59,287.69	0.02
425	600202	哈空调	16,600	59,262.00	0.02
426	600356	恒丰纸业	10,000	59,200.00	0.02
427	001231	农心科技	4,200	59,094.00	0.02
428	603298	杭叉集团	3,000	58,920.00	0.02
429	603182	嘉华股份	5,600	58,912.00	0.02
430	600448	华纺股份	29,900	58,903.00	0.02
431	002696	百洋股份	14,900	58,855.00	0.02
432	002687	乔治白	14,000	58,800.00	0.02
433	002836	新宏泽	10,000	58,700.00	0.02
434	300658	延江股份	13,900	58,658.00	0.02
435	300877	金春股份	5,400	58,536.00	0.02
436	301234	五洲医疗	2,700	58,455.00	0.02
437	002890	弘宇股份	7,280	58,385.60	0.02
438	002817	黄山胶囊	10,900	58,206.00	0.02
439	003003	天元股份	7,300	58,181.00	0.02
440	600137	浪莎股份	4,900	58,163.00	0.02
441	600156	华升股份	18,700	58,157.00	0.02
442	600802	福建水泥	20,900	58,102.00	0.02
443	000333	美的集团	900	58,050.00	0.02
444	002486	嘉麟杰	40,000	58,000.00	0.02
444	600082	海泰发展	29,000	58,000.00	0.02
445	688290	景业智能	1,800	57,780.00	0.02
446	688178	万德斯	5,600	57,736.00	0.02
447	00576	浙江沪杭甬	12,000	57,717.88	0.02
448	300385	雪浪环境	17,100	57,627.00	0.02
449	688379	华光新材	4,200	57,582.00	0.02
450	600371	万向德农	8,300	57,436.00	0.02
451	688067	爱威科技	4,000	57,400.00	0.02
452	601996	丰林集团	33,800	57,122.00	0.02
453	688679	通源环境	8,200	57,072.00	0.02
454	000528	柳工	5,100	57,069.00	0.02
455	688335	复洁环保	7,000	57,050.00	0.02
455	688350	富淼科技	5,000	57,050.00	0.02
456	688395	正弦电气	4,000	57,000.00	0.02

457	002094	青岛金王	31,700	56,743.00	0.02
458	688448	磁谷科技	3,000	56,640.00	0.02
459	688215	瑞晟智能	2,400	56,616.00	0.02
460	688096	京源环保	11,200	56,560.00	0.02
461	688013	天臣医疗	3,800	56,392.00	0.02
462	002859	洁美科技	2,800	56,224.00	0.02
463	688367	工大高科	4,600	56,120.00	0.02
464	688571	杭华股份	10,600	56,074.00	0.02
465	688026	洁特生物	5,600	55,776.00	0.02
466	000608	阳光股份	38,500	54,670.00	0.02
467	300502	新易盛	500	52,775.00	0.02
468	600758	辽宁能源	17,700	50,622.00	0.02
469	000923	河钢资源	2,900	49,938.00	0.02
470	600422	昆药集团	2,800	49,924.00	0.02
471	02866	中远海发	48,000	49,503.76	0.02
472	000821	京山轻机	4,100	46,453.00	0.02
473	09626	哔哩哔哩-W	400	46,327.64	0.02
474	002958	青农商行	17,200	46,096.00	0.02
475	600578	京能电力	14,200	46,008.00	0.02
476	600582	天地科技	6,600	45,474.00	0.01
477	601016	节能风电	15,100	45,149.00	0.01
478	300729	乐歌股份	2,900	44,921.00	0.01
479	000683	远兴能源	6,500	44,915.00	0.01
480	300908	仲景食品	1,606	44,614.68	0.01
481	600929	雪天盐业	8,400	44,520.00	0.01
482	002508	老板电器	2,000	44,200.00	0.01
483	002004	华邦健康	11,600	44,080.00	0.01
484	002010	传化智联	11,400	43,776.00	0.01
485	002705	新宝股份	3,100	43,617.00	0.01
486	000408	藏格矿业	1,800	43,326.00	0.01
487	300012	华测检测	4,300	43,258.00	0.01
488	00777	网龙	4,000	43,078.50	0.01
489	600221	海航控股	42,200	43,044.00	0.01
490	000783	长江证券	8,900	42,987.00	0.01
491	02669	中海物业	10,000	42,713.42	0.01
492	002120	韵达股份	5,500	42,570.00	0.01
493	00144	招商局港口	4,000	42,421.37	0.01
494	301015	百洋医药	1,800	42,354.00	0.01
495	002430	杭氧股份	1,900	42,275.00	0.01
496	01024	快手-W	1,000	42,120.18	0.01
497	601101	昊华能源	4,200	38,598.00	0.01
498	002683	广东宏大	1,900	38,247.00	0.01
499	601127	赛力斯	400	36,448.00	0.01
500	00384	中国燃气	5,400	34,499.30	0.01

501	600681	百川能源	9,700	32,689.00	0.01
502	600229	城市传媒	4,600	31,694.00	0.01
503	601186	中国铁建	3,400	29,138.00	0.01
504	601137	博威合金	1,900	28,956.00	0.01
505	300303	聚飞光电	5,600	27,216.00	0.01
506	300105	龙源技术	3,900	25,194.00	0.01
507	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
508	00388	香港交易所	100	22,835.25	0.01
509	603816	顾家家居	700	22,603.00	0.01
510	600846	同济科技	3,300	22,539.00	0.01
511	000877	天山股份	4,100	22,140.00	0.01
512	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
513	601997	贵阳银行	4,000	21,080.00	0.01
514	002170	芭田股份	3,400	20,434.00	0.01
515	688692	达梦数据	109	19,067.37	0.01
516	002439	启明星辰	1,100	18,986.00	0.01
517	600020	中原高速	5,200	18,408.00	0.01
518	603680	今创集团	2,700	17,820.00	0.01
519	002615	哈尔斯	2,700	16,740.00	0.01
520	000708	中信特钢	1,200	16,284.00	0.01
521	000581	威孚高科	1,000	16,280.00	0.01
522	002242	九阳股份	1,500	15,720.00	0.01
523	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.01
524	002422	科伦药业	500	15,165.00	0.00
525	002962	五方光电	1,000	15,120.00	0.00
526	600873	梅花生物	1,500	15,030.00	0.00
527	600585	海螺水泥	600	14,154.00	0.00
528	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
529	002296	辉煌科技	1,300	13,403.00	0.00
530	301565	中仑新材	686	13,020.28	0.00
531	301580	爱迪特	189	12,460.77	0.00
532	600717	天津港	2,800	11,956.00	0.00
533	002111	威海广泰	1,100	11,462.00	0.00
534	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
535	688709	成都华微	523	9,827.17	0.00
536	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
537	003021	兆威机电	200	9,230.00	0.00
538	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
539	300752	隆利科技	600	8,148.00	0.00
540	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
541	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
542	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
543	300253	卫宁健康	1,300	7,670.00	0.00
544	300709	精研科技	300	7,584.00	0.00

545	600711	盛屯矿业	2,000	7,340.00	0.00
546	003028	振邦智能	200	7,212.00	0.00
547	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
548	301102	兆讯传媒	600	7,074.00	0.00
549	300623	捷捷微电	400	6,920.00	0.00
550	603160	汇顶科技	100	6,875.00	0.00
551	300522	世名科技	600	6,630.00	0.00
552	688584	上海合晶	414	6,578.46	0.00
553	603227	雪峰科技	1,000	6,200.00	0.00
554	601033	永兴股份	383	6,112.68	0.00
555	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
556	603341	龙旗科技	156	5,848.44	0.00
557	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
558	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
559	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
560	603588	高能环境	800	5,024.00	0.00
561	600637	东方明珠	700	4,256.00	0.00
562	603035	常熟汽饰	300	3,804.00	0.00
563	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
564	600757	长江传媒	400	3,224.00	0.00
565	603381	永臻股份	128	3,216.64	0.00
566	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
567	603325	博隆技术	45	3,062.70	0.00
568	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
569	001379	腾达科技	199	2,682.52	0.00
570	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
571	603312	西典新能	104	2,637.44	0.00
572	603565	中谷物流	300	2,622.00	0.00
573	002601	龙佰集团	100	1,857.00	0.00
574	601339	百隆东方	300	1,563.00	0.00
575	002749	国光股份	100	1,504.00	0.00
576	600507	方大特钢	400	1,496.00	0.00
577	601900	南方传媒	100	1,243.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	6,140,799.00	2.10
2	600548	深高速	5,711,794.00	1.95

3	600019	宝钢股份	5,295,991.00	1.81
4	002154	报喜鸟	5,274,153.00	1.80
5	601390	中国中铁	4,240,595.00	1.45
5	00390	中国中铁	916,520.09	0.31
6	601939	建设银行	4,909,417.00	1.68
7	601088	中国神华	4,124,534.00	1.41
7	01088	中国神华	751,282.18	0.26
8	601668	中国建筑	4,842,530.00	1.65
9	601818	光大银行	4,585,096.00	1.57
10	600377	宁沪高速	4,444,951.00	1.52
11	600398	海澜之家	4,437,012.00	1.51
12	600710	苏美达	4,415,670.00	1.51
13	601598	中国外运	4,203,782.00	1.44
14	601229	上海银行	4,139,636.00	1.41
15	601328	交通银行	3,367,515.00	1.15
15	03328	交通银行	683,831.76	0.23
16	601658	邮储银行	4,030,355.00	1.38
17	600015	华夏银行	3,915,074.00	1.34
18	600373	中文传媒	3,847,915.00	1.31
19	002327	富安娜	3,807,035.00	1.30
20	002674	兴业科技	3,786,772.00	1.29

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601998	中信银行	7,129,151.99	2.43
1	00998	中信银行	638,013.54	0.22
2	002818	富森美	7,186,622.42	2.45
3	601328	交通银行	6,507,352.00	2.22
3	03328	交通银行	550,740.92	0.19
4	600282	南钢股份	6,908,097.00	2.36
5	601668	中国建筑	6,708,941.00	2.29
6	601398	工商银行	6,563,704.00	2.24
7	000429	粤高速 A	6,335,975.00	2.16
8	600028	中国石化	5,408,600.00	1.85
8	00386	中国石油化工股份	464,544.53	0.16

9	600971	恒源煤电	5,790,644.00	1.98
10	601019	山东出版	5,741,221.00	1.96
11	601077	渝农商行	5,713,317.00	1.95
11	03618	重庆农村商业银行	16,102.84	0.01
12	600177	雅戈尔	5,719,920.60	1.95
13	601818	光大银行	5,429,139.00	1.85
14	000937	冀中能源	5,384,885.00	1.84
15	600548	深高速	5,349,477.00	1.83
16	600919	江苏银行	5,163,392.00	1.76
17	601939	建设银行	5,081,341.00	1.73
18	601169	北京银行	5,068,706.00	1.73
19	600350	山东高速	5,041,616.00	1.72
20	601298	青岛港	4,987,485.00	1.70

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	874,238,326.89
卖出股票收入（成交）总额	871,773,955.31

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	10,592,300.27	3.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	102,173.15	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,694,473.42	3.50

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019727	23 国债 24	104,000	10,592,300.27	3.47
2	113048	晶科转债	230	21,736.58	0.01
3	128101	联创转债	200	21,602.43	0.01
4	123091	长海转债	180	20,177.04	0.01
5	113053	隆 22 转债	190	19,332.57	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，长沙银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）的处罚。中国银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主

体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	49,629.77
2	应收清算款	1,453,898.58
3	应收股利	270,708.17
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,438.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,790,674.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113048	晶科转债	21,736.58	0.01
2	128101	联创转债	21,602.43	0.01
3	123091	长海转债	20,177.04	0.01
4	113053	隆 22 转债	19,332.57	0.01
5	113605	大参转债	19,324.53	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发高股息优享混合 A	4,472	54,512.75	90,175,648.97	36.99%	153,605,376.17	63.01%
广发高股息优享混合 C	2,477	26,986.96	301,221.16	0.45%	66,545,470.09	99.55%
合计	6,949	44,701.07	90,476,870.13	29.13%	220,150,846.26	70.87%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发高股息优享混合 A	5,578.92	0.0023%
	广发高股息优享混合 C	0.00	0.0000%
	合计	5,578.92	0.0018%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发高股息优享混合 A	0
	广发高股息优享混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发高股息优享混合 A	0~10
	广发高股息优享混合 C	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发高股息优享混合 A	广发高股息优享混合 C
基金合同生效日（2020 年 1 月 20 日）基金份额总额	3,557,926,568.23	1,215,585,451.87
本报告期期初基金份额总额	249,456,210.24	62,687,761.76
本报告期基金总申购份额	5,166,423.92	19,980,729.67
减：本报告期基金总赎回份额	10,841,609.02	15,821,800.18
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	243,781,025.14	66,846,691.25

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中航证券	2	893,231,380.59	51.20%	665,742.24	50.12%	-
财通证券	2	315,995,808.66	18.11%	235,705.77	17.74%	-
国盛证券	1	300,437,713.41	17.22%	224,092.86	16.87%	-
广发证券	3	144,840,772.60	8.30%	136,051.31	10.24%	-
五矿证券	1	89,893,867.40	5.15%	66,674.74	5.02%	-
招商证券	1	160,326.62	0.01%	96.20	0.01%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中航证券	1,754,290.76	8.47%	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	17,428,493.31	84.11%	19,000,000.00	100.00%	-	-
广发证券	1,335,721.78	6.45%	-	-	-	-
五矿证券	201,541.04	0.97%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发高股息优享混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发高股息优享混合型证券投资基金基金合同》

- (三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四)《广发高股息优享混合型证券投资基金托管协议》
- (五)法律意见书
- (六)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七)基金托管人业务资格批件、营业执照

11.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日